

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 26 de agosto de 2024**  
**Fecha de Información: 22 de agosto de 2024<sup>1</sup>**

Según el reporte de los Sistemas de Información y Registro de Operaciones sobre Divisas del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$4025 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.21%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragruppo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	853,0	618,6	223,2	489,0	49,4	17,9	346,1
15-35	1257,3	1278,7	653,7	573,9	35,7	94,0	589,4
36-60	8,2	4,1	0,0	0,0	4,1	8,2	0,0
61-90	48,5	384,4	332,0	0,1	46,5	42,6	5,9
91-180	44,3	259,3	240,2	23,6	19,2	20,7	0,0
>180	132,9	132,3	64,6	73,8	12,6	4,1	55,0
<b>Total</b>	<b>2344,1</b>	<b>2677,5</b>	<b>1513,7</b>	<b>1160,3</b>	<b>167,4</b>	<b>187,5</b>	<b>996,4</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

<sup>c</sup> Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior

Cuadro No. 2 Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario <sup>a</sup>	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5.32%	5.37%	5.08%	5.23%
15-35	5.30%	5.22%	5.05%	5.19%
36-60	–	5.42%	4.61%	4.89%
61-90	5.26%	5.43%	4.93%	5.32%
91-180	–	5.19%	5.03%	5.18%
>180	5.09%	5.15%	5.07%	5.09%
<b>Total</b>	<b>5.29%</b>	<b>5.26%</b>	<b>5.05%</b>	<b>5.21%</b>

<sup>a</sup> Incluye solo operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

<sup>1</sup>A partir del 7 de diciembre se calcula este reporte incorporando la información preliminar reportada por los Sistemas de Información y Registro de Operaciones sobre divisas al Banco de la República.

<sup>2</sup>El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards<sup>a</sup>

Sectores	19 – 23 ago.				26 - 30 ago.				02 - 06 sept.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	25	109	4663	4643	62	209	8716	9426	33	81	6457	7381
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2319	2416	0	0	4748	3686	0	0	3935	2315
Otros <sup>c</sup>	109	25	664	569	209	62	977	1321	81	33	498	1164
<b>Total</b>	<b>134</b>	<b>134</b>	<b>7646</b>	<b>7628</b>	<b>271</b>	<b>271</b>	<b>14441</b>	<b>14433</b>	<b>114</b>	<b>114</b>	<b>10890</b>	<b>10860</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares.

<sup>b</sup> Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

<sup>c</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes